

GLOBE INDEX (GI)

Risikokennzahlen

1 Jahr	Return	Volatilität	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Beta	Jensen Alpha	Max. kumulierter Verlust	Erholungsdauer
GLOBE INDEX I	11.00 %	16.61 %	0.05 %	0.63	3.81	1.00	0.18 %	-13.62 %	5.00
GLOBE INDEX II	11.05 %	16.61 %	0.05 %	0.64	4.67	1.00	0.23 %	-13.61 %	5.00
GLOBE INDEX III	11.13 %	16.61 %	0.05 %	0.64	6.19	1.00	0.31 %	-13.60 %	5.00
GLOBE INDEX G	11.15 %	16.61 %	0.05 %	0.64	6.53	1.00	0.32 %	-13.60 %	5.00
MSCI World ex-CH ndr	10.81 %	17.25 %	-	0.60	-	-	-	-13.65 %	5.00

Beobachtungszeitraum: 01.10.2024 bis 30.09.2025 Berechnungsbasis: monatlich

3 Jahre	Return	Volatilität	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Beta	Jensen Alpha	Max. kumulierter Verlust	Erholungsdauer
GLOBE INDEX I	15.70 %	12.88 %	0.08 %	1.18	2.57	1.00	0.25 %	-13.62 %	5.00
GLOBE INDEX II	15.75 %	12.88 %	0.08 %	1.19	3.09	1.00	0.29 %	-13.61 %	5.00
GLOBE INDEX III	15.84 %	12.88 %	0.08 %	1.19	4.02	1.00	0.38 %	-13.60 %	5.00
GLOBE INDEX G	15.85 %	12.88 %	0.08 %	1.20	4.21	1.00	0.39 %	-13.60 %	5.00
MSCI World ex-CH ndr	15.47 %	12.89 %	-	1.17	-	-	-	-13.65 %	5.00

Beobachtungszeitraum: 01.10.2022 bis 30.09.2025 Berechnungsbasis: monatlich

5 Jahre	Return	Volatilität	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Beta	Jensen Alpha	Max. kumulierter Verlust	Erholungsdauer
GLOBE INDEX I	11.55 %	14.44 %	0.08 %	0.77	2.32	1.00	0.20 %	-19.38 %	17.00
GLOBE INDEX II	11.60 %	14.44 %	0.08 %	0.77	2.83	1.00	0.24 %	-19.36 %	17.00
GLOBE INDEX III	11.68 %	14.44 %	0.08 %	0.78	3.75	1.00	0.33 %	-19.31 %	17.00
GLOBE INDEX G	11.70 %	14.44 %	0.08 %	0.78	3.95	1.00	0.34 %	-19.30 %	17.00
MSCI World ex-CH ndr	11.35 %	14.43 %	-	0.76	-	-	-	-19.42 %	17.00

Beobachtungszeitraum: 01.10.2020 bis 30.09.2025 Berechnungsbasis: monatlich

10 Jahre	Return	Volatilität	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Beta	Jensen Alpha	Max. kumulierter Verlust	Erholungsdauer
GLOBE INDEX I	10.48 %	14.42 %	0.08 %	0.70	2.39	1.00	0.21 %	-21.54 %	8.00
GLOBE INDEX II	10.54 %	14.42 %	0.08 %	0.70	3.02	1.00	0.27 %	-21.53 %	8.00
GLOBE INDEX III	10.61 %	14.42 %	0.08 %	0.71	3.84	1.00	0.34 %	-21.51 %	8.00
GLOBE INDEX G	10.64 %	14.42 %	0.08 %	0.71	4.17	1.00	0.37 %	-21.50 %	8.00
MSCI World ex-CH ndr	10.27 %	14.43 %	-	0.68	-	-	-	-21.61 %	8.00

Beobachtungszeitraum: 01.10.2015 bis 30.09.2025 Berechnungsbasis: monatlich

Risikofreier Zinssatz: 0.38 % (Libor CHF 3 Monate)

Angaben ohne Gewähr

Kennzahl	Berechnung	Beschreibung
Volatilität	$\sqrt{\text{Varianz}}$	Durchschnittliche Schwankungen der absoluten Rendite um ihren Mittelwert
Sharpe-Ratio	$\frac{\text{Rendite Portfolio p.a.} - \text{risikoloser Zinssatz p.a.}}{\text{Volatilität Portfolio}}$	Absolute Überschussrendite pro Einheit eingegangenem Gesamtrisiko
Tracking Error	Standardabweichung (Rendite Portfolio p.a. – Rendite Benchmark p.a.)	Durchschnittliche Schwankung der Portfoliorendite um die Benchmarkrendite (Volatilität der relativen Rendite = aktives Risiko) Tracking Error zeigt an, wie benchmarknah ein Vermögen verwaltet wird
Information Ratio	$\frac{\text{Rendite Portfolio p.a.} - \text{Rendite Benchmark p.a.}}{\text{Tracking Error}}$	Mehr- oder Minderrendite pro eingegangenem aktiven Risiko
Beta-Faktor	$\frac{\text{Kovarianz zwischen Rendite Portfolio und Rendite Benchmark}}{\text{Varianz Rendite Benchmark}}$	Übernommenes Marktrisiko / Sensibilität auf Preisveränderungen des Marktes
Jensen-Alpha	$\text{Rendite Portfolio p.a.} - \text{risikoloser Zinssatz p.a.} - \beta \times (\text{Rendite Benchmark p.a.} - \text{risikoloser Zinssatz p.a.})$	Durchschnittliche risikobereinigte Mehr- oder Minderrendite
Maximum Drawdown (maximaler kumulierter Verlust)	$\frac{\text{Tiefster Portfoliowert nach Kurseinbruch} - \text{Höchster Portfoliowert vorher}}{\text{Höchster Portfoliowert vorher}}$	Maximaler Gesamtverlust innerhalb eines Betrachtungszeitraumes unabhängig von zwischenzeitlichen teilweisen Erholungen
Recovery Period (Erholungsdauer)	$\frac{\text{Datum Wiedererreichung Höchster Portfoliowert} - \text{Datum Tiefster Portfoliowert}}{\text{nach Kurseinbruch gemäss gewählter Periode bei Maximum Drawdown}}$	Zeitdauer bis zur Kompensation des vorangehenden Maximalverlustes
Modified Duration	$\frac{\text{Restlaufzeitgewichteter Barwert der Obligation}}{\text{Barwert der Obligation}}$	Sensitivitätsmass auf Veränderungen des Zinsniveaus